

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Fecha de Publicación: 28 de diciembre de 2020
Fecha de Información: 23 de diciembre de 2020¹

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1096 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.51%².

Cuadro No. 1 Contratos Forwards Pactados^a

| Rango | Sector Financiero ^b | | Intragrupo y Off-shore ^c | | Otros Agentes | | |
|--------------|--------------------------------|--------------|-------------------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Interbancarios |
| 3-14 | 300,7 | 111,7 | 57,7 | 208,2 | 11,0 | 49,5 | 43,0 |
| 15-35 | 339,0 | 356,8 | 176,4 | 159,2 | 39,4 | 38,8 | 141,0 |
| 36-60 | 21,9 | 42,1 | 26,6 | 0,0 | 12,9 | 19,4 | 2,5 |
| 61-90 | 4,4 | 13,2 | 0,6 | 0,0 | 12,6 | 4,4 | 0,0 |
| 91-180 | 13,8 | 32,7 | 1,0 | 0,0 | 22,2 | 4,3 | 9,5 |
| >180 | 30,2 | 35,2 | 15,0 | 0,0 | 10,2 | 20,2 | 10,0 |
| Total | 710,0 | 591,6 | 277,3 | 367,4 | 108,3 | 136,6 | 206,0 |

^a Cifras en millones de dólares

^b Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior

Cuadro No. 2 Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

| Rango | Sector Financiero ^a | | Otros Agentes sin intragrupo | | Total |
|--------------|--------------------------------|--|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 0.28% | | 0.44% | 0.22% | 0.30% |
| 15-35 | 0.38% | | 0.38% | 0.22% | 0.32% |
| 36-60 | 0.60% | | 0.69% | 0.29% | 0.46% |
| 61-90 | — | | 1.31% | 0.94% | 1.22% |
| 91-180 | 1.31% | | 1.68% | 1.27% | 1.53% |
| >180 | 1.93% | | 1.98% | 1.76% | 1.89% |
| Total | 0.48% | | 0.73% | 0.35% | 0.51% |

^a Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

¹Datos provisionales.

²El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) ^ (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.

“Cuadro No. 3 Vencimientos de Forwards

| Sectores | 21 - 25 dic. | | | | 28 dic. - 01 ene. | | | | 04 - 08 ene. | | | |
|-------------------------------------|--------------|-----------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|--------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero ^a | 35 | 61 | 2706 | 2436 | 18 | 133 | 2597 | 2875 | 16 | 118 | 3693 | 3731 |
| Intragrupo y off-shore ^b | 0 | 0 | 1613 | 1931 | 0 | 0 | 1814 | 1632 | 0 | 0 | 2314 | 1945 |
| Otros ^c | 61 | 35 | 215 | 168 | 133 | 18 | 364 | 269 | 118 | 16 | 372 | 703 |
| Total | 96 | 96 | 4534 | 4535 | 151 | 151 | 4775 | 4776 | 134 | 134 | 6379 | 6379 |

^a Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

^b Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

^c Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.